

GBMfondos

GBMF3 GBM VALORES DE DEUDA, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 30 ABRIL, 2025

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES F	261203	mxAAA	6,000,000	599,989,794.00	8.47
LF	BONDES F	270520	mxAAA	4,000,000	399,601,752.00	5.64
LF	BONDES F	270819	mxAAA	1,500,000	149,559,630.00	2.11
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	251204	mxAAA	915,972	782,445,082.53	11.05
S	UDIBONO	261203	mxAAA	684,614	567,457,760.16	8.01
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				1,750,000	175,838,656.30	2.48
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				3,910,501	381,468,904.91	5.39
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL						
OTROS TIPO DE VALOR 92 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL				2,099,317	204,803,081.38	2.89
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	ORBIA	25	AAA(mex)	1,450,000	145,845,136.85	2.06
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				14,384,469	1,369,001,524.21	19.33
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
OTROS TIPO DE VALOR 95 - CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO				2,040,586	206,033,775.26	2.91
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
OTROS TIPO DE VALOR JI - TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES				3,302,000	332,057,800.61	4.69
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
D8	CIT1125	FLOAT	A	62	155,689,895.20	2.20
OTROS TIPO DE VALOR D8 - TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC				57	143,624,148.27	2.03
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					5,613,416,941.68	79.25
REPORTO						
2U	CBIC002	300117	mxAAA	734,939	700,335,878.41	9.89
LF	BONDES F	261001	mxAAA	4,876,309	487,978,304.64	6.89
TOTAL REPORTO					1,188,314,183.05	16.78
OTROS VALORES				22,032,115	281,616,377.02	3.98
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					7,083,347,501.75	100.00

CATEGORÍA
IDDIS

CALIFICACIÓN
AAAf/S4(mex)

VaR Promedio
0.020%

Límite de VaR
0.470%

Para llevar a cabo la estimación del Valor en Riesgo (VaR) de mercado para las Fondos de Inversión administrados por Operadora GBM, se acordó con la empresa Valor de Mercado (Valmer) que sea ella quien lo realice, siguiendo los criterios metodológicos aprobados por la Unidad de Administración Integral de riesgos de la Operadora.

El método utilizado para la estimación del VaR es el conocido como simulación histórica, con los parámetros que se presentan a continuación:

- Un periodo de muestra de un año
- El nivel de confianza para el VaR fijado al 95%
- El horizonte temporal para el que se estime la posible minusvalía será de 1 día